

**単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項**  
(2024年6月期)

(別紙様式第三号)

(単位：百万円、%、件)

| 項目                      |                                                 | 当四半期         |              | 前四半期         |              |
|-------------------------|-------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>       |                                                 |              |              |              |              |
| 1                       | 適格流動資産の合計額                                      | 2,435,350    |              | 2,782,914    |              |
| <b>資金流出額 (2)</b>        |                                                 | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 |
| 2                       | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                             | 5,633,050    | 467,479      | 5,648,518    | 468,263      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 1,373,656    | 41,209       | 1,385,302    | 41,559       |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 4,259,394    | 426,270      | 4,263,216    | 426,704      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,237,004    | 855,738      | 2,505,746    | 1,188,868    |
| 6                       | うち、適格オペレーショナル預金の額                               | -            | -            | -            | -            |
| 7                       | うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 2,181,972    | 800,706      | 2,422,971    | 1,106,094    |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 55,031       | 55,031       | 82,774       | 82,774       |
| 9                       | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | -            |              | 748          |
| 10                      | デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額       | 166,588      | 52,313       | 157,937      | 51,296       |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 36,973       | 36,973       | 36,019       | 36,019       |
| 12                      | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                            | -            | -            | -            | -            |
| 13                      | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                         | 129,615      | 15,340       | 121,918      | 15,277       |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 14,494       | 5,080        | 8,514        | 4,616        |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 1,251,603    | 41,072       | 1,259,469    | 40,001       |
| 16                      | 資金流出合計額                                         |              | 1,421,685    |              | 1,753,794    |
| <b>資金流入額 (3)</b>        |                                                 | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 |
| 17                      | 有担保資金運用等に係る資金流入額                                | -            | -            | -            | -            |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 306,430      | 176,701      | 328,445      | 190,205      |
| 19                      | その他資金流入額                                        | 43,855       | 20,670       | 38,554       | 15,250       |
| 20                      | 資金流入合計額                                         | 350,285      | 197,371      | 366,999      | 205,456      |
| <b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b> |                                                 |              |              |              |              |
| 21                      | 算入可能適格流動資産の合計額                                  |              | 2,435,350    |              | 2,782,914    |
| 22                      | 純資金流出額                                          |              | 1,224,313    |              | 1,548,338    |
| 23                      | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 198.9%       |              | 179.7%       |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      |              | 62           |              | 58           |